高等数学

1.导数定义：

导数和微分的概念

$f'(x_0) = \lim_{\Delta x \to 0} \frac{f(x_0+\Delta x)-f(x_0)}{\Delta x}$ （1）

或者：

$f'(x_0) = \lim_{x \to x_0} \frac{f(x)-f(x_0)}{x-x_0}$ （2）

2.左右导数导数的几何意义和物理意义

函数$f(x)$在x_0处的左、右导数分别定义为：

左导数：$f'_{-}(x_0) = \lim_{\Delta x \to 0^-} \frac{f(x_0+\Delta x)-f(x_0)}{\Delta x} = \lim_{x \to x_0^-} \frac{f(x)-f(x_0)}{x-x_0}, (x = x_0 + \Delta x)$

右导数：$f'_{+}(x_0) = \lim_{\Delta x \to 0^+} \frac{f(x_0+\Delta x)-f(x_0)}{\Delta x} = \lim_{x \to x_0^+} \frac{f(x)-f(x_0)}{x-x_0}$

3.函数的可导性与连续性之间的关系

Th1: 函数$f(x)$在x_0处可微$\Leftrightarrow$ $f(x)$在x_0处可导

Th2: 若函数在点x_0处可导，则$y=f(x)$在点x_0处连续，反之则不成立。即函数连续不一定可导。

Th3: $f'(x_0)$存在$\Leftrightarrow$ $f'_-(x_0)=f'_+(x_0)$

4.平面曲线的切线和法线

切线方程 : $y-y_0=f'(x_0)(x-x_0)$

法线方程：$y-y_0=-\frac{1}{f'(x_0)}(x-x_0), f'(x_0)\neq 0$

5.四则运算法则

设函数$u=u(x)$，$v=v(x)$]在点x可导则

(1) $(u\pm v)'=u'\pm v'$ $d(u\pm v)=du\pm dv$

(2)$(uv)'=uv'+vu'$ $d(uv)=udv+vdu$

(3) $(\frac{u}{v})'=\frac{vu'-uv'}{v^2}(v\neq 0)$ $d(\frac{u}{v})=\frac{vdu-udv}{v^2}$

6.基本导数与微分表

(1) $y=c$（常数） $y'=0$ $dy=0$

(2) $y=x^\alpha$(α为实数) $y'=\alpha x^{\alpha-1}$ $dy=\alpha x^{\alpha-1}dx$

(3) $y=a^x$ $y'=a^x\ln a$ $dy=a^x\ln a dx$
特例: $(e^x)'=e^x$ $d(e^x)=e^x dx$

(4) $y=\log_a x$ $y'=\frac{1}{x\ln a}$

$dy=\frac{1}{x\ln a}dx$
特例:$y=\ln x$ $(\ln x)'=\frac{1}{x}$ $d(\ln x)=\frac{1}{x}dx$

(5) $y=\sin x$

$y'=\cos x$ $d(\sin x)=\cos x dx$

(6) $y=\cos x$

$y'=-\sin x$ $d(\cos x)=-\sin x dx$

(7) $y=\tan x$

$y'=\frac{1}{\cos^2 x}=\sec^2 x$ $d(\tan x)=\sec^2 x dx$

(8) $y=\cot x$ $y'=-\frac{1}{\sin^2 x}=-\csc^2 x$ $d(\cot x)=-\csc^2 x dx$

(9) $y=\sec x$ $y'=\sec x\tan x$

$d(\sec x) = \sec x \tan x dx$
(10) $y = \csc x$ $y' = -\csc x \cot x$

$d(\csc x) = -\csc x \cot x dx$
(11) $y = \arcsin x$

$y' = \frac{1}{\sqrt{1-x^2}}$

$d(\arcsin x) = \frac{1}{\sqrt{1-x^2}} dx$
(12) $y = \arccos x$

$y' = -\frac{1}{\sqrt{1-x^2}}$ $d(\arccos x) = -\frac{1}{\sqrt{1-x^2}} dx$

(13) $y = \arctan x$

$y' = \frac{1}{1+x^2}$ $d(\arctan x) = \frac{1}{1+x^2} dx$

(14) $y = \operatorname{arc}\cot x$

$y' = -\frac{1}{1+x^2}$

$d(\operatorname{arc}\cot x) = -\frac{1}{1+x^2} dx$
(15) $y = shx$

$y' = chx$ $d(shx) = chxdx$

(16) $y = chx$

$y' = shx$ $d(chx) = shxdx$

7.复合函数，反函数，隐函数以及参数方程所确定的函数的微分法

(1) 反函数的运算法则: 设$y = f(x)$在点x的某邻域内单调连续，在点x处可导且$f'(x) \neq 0$，则其反函数在点x所对应的y处可导，并且有$\frac{dy}{dx} = \frac{1}{\frac{dx}{dy}}$

(2) 复合函数的运算法则:若$\mu = \varphi(x)$在点x可导,而$y = f(\mu)$在对应点μ($\mu = \varphi(x)$)可导,则复合函数$y = f(\varphi(x))$在点x可导,且$y' = f'(\mu) \cdot \varphi'(x)$

(3) 隐函数导数$\frac{dy}{dx}$的求法一般有三种方法:

1)方程两边对x求导，要记住y是x的函数，则y的函数是x的复合函数.例如$\frac{1}{y}$，y^2，lny，e^y等均是x的复合函数.
对x求导应按复合函数连锁法则做.

2)公式法.由$F(x,y) = 0$知 $\frac{dy}{dx} = -\frac{F'_x(x,y)}{F'_y(x,y)}$,其中，$F'_x(x,y)$，
$F'_y(x,y)$分别表示$F(x,y)$对x和y的偏导数

3)利用微分形式不变性

8.常用高阶导数公式

(1) $(a^x)^{(n)} = a^x \ln^n a \quad (a > 0) \qquad (e^x)^{(n)} = e^x$

(2) $(\sin kx)^{(n)} = k^n \sin(kx + n \cdot \frac{\pi}{2})$

(3) $(\cos kx)^{(n)} = k^n \cos(kx + n \cdot \frac{\pi}{2})$

（4）$(x^m)^{(n)} = m(m-1)\cdots(m-n+1)x^{m-n}$

（5）$(\ln x)^{(n)} = (-1)^{(n-1)}\frac{(n-1)!}{x^n}$

（6）莱布尼兹公式：若$u(x)$，$v(x)$均n阶可导，则 $(uv)^{(n)} = \sum\limits_{i=0}^{n} c_n^i u^{(i)} v^{(n-i)}$，其中$u^{(0)} = u$，$v^{(0)} = v$

9.微分中值定理，泰勒公式

Th1:(费马定理)

若函数$f(x)$满足条件：

(1)函数$f(x)$在x_0的某邻域内有定义，并且在此邻域内恒有 $f(x) \leq f(x_0)$或$f(x) \geq f(x_0)$,

(2) $f(x)$在x_0处可导,则有 $f'(x_0) = 0$

Th2:(罗尔定理)

设函数$f(x)$满足条件：

(1)在闭区间$[a,b]$上连续；

(2)在(a,b)内可导；

(3)$f(a) = f(b)$；

则在(a,b)内一存在个ξ，使 $f'(\xi) = 0$

Th3: (拉格朗日中值定理)

设函数$f(x)$满足条件：

(1)在$[a,b]$上连续；

(2)在(a,b)内可导；

则在(a,b)内一存在个ξ，使 $\frac{f(b)-f(a)}{b-a} = f'(\xi)$

Th4: (柯西中值定理)

设函数$f(x)$，$g(x)$满足条件：
(1) 在$[a,b]$上连续；

(2) 在(a,b)内可导且$f'(x)$，$g'(x)$均存在，且$g'(x) \neq 0$

则在(a,b)内存在一个ξ，使 $\frac{f(b)-f(a)}{g(b)-g(a)} = \frac{f'(\xi)}{g'(\xi)}$

10.洛必达法则

法则 Ⅰ ($\frac{0}{0}$型)

设函数$f\left(x\right),g\left(x\right)$

满足条件:

$\lim_{x\rightarrow x_0}\ f\left(x\right)=0,\lim_{x\rightarrow x_0}\ g\left(x\right)=0$;

$f\left(x\right),g\left(x\right)$在$x_0$的邻域内可导，(在$x_0$处可除外)且$g'\left(x\right)\neq0$;

$\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f'(x)}{g'(x)}$存在(或$\infty$)。

则:
$\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f(x)}{g(x)}=\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f'(x)}{g'(x)}$。
法则I' ($\frac{0}{0}$型)

设函数$f\left(x\right),g\left(x\right)$

满足条件:

$\lim_{x\rightarrow\infty}\ f\left(x\right)=0,\lim_{x\rightarrow\infty}\ g\left(x\right)=0$;

存在一个$X>0$,当$\left|x\right|>X$时,$f\left(x\right),g\left(x\right)$可导,且$g'\left(x\right)\neq0$;$\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f'(x)}{g'(x)}$存在(或$\infty$)。

则:
$\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f(x)}{g(x)}=\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f'(x)}{g'(x)}$

法则 Ⅱ($\frac{\infty}{\infty}$型)

设函数$f\left(x\right),g\left(x\right)$满足条件:
$\lim_{x\rightarrow x_0}\ f\left(x\right)=\infty,\lim_{x\rightarrow x_0}\ g\left(x\right)=\infty$;

$f\left(x\right),g\left(x\right)$在$x_0$ 的邻域内可导(在x_0处可除外)且$g'\left(x\right)\neq0$;$\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f'(x)}{g'(x)}$存在(或$\infty$)。

则

$\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f(x)}{g(x)}=\lim_{x\rightarrow x_0}\ \frac{f'(x)}{g'(x)}$.

同理法则II'($\frac{\infty}{\infty}$型)仿法则I'可写出。

11.泰勒公式

设函数$f(x)$在点x_0处的某邻域内具有$n+1$阶导数，则对该邻域内异于x_0的任意点x，在x_0与x之间至少存在
一个ξ，使得:

$f(x)=f(x_0)+f'(x_0)(x-x_0)+\frac{1}{2!}f''(x_0){(x-x_0)}^2+\cdots$

$+\frac{f^{(n)}(x_0)}{n!}{(x-x_0)}^n+R_n(x)$

其中 $R_n(x)=\frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!}{(x-x_0)}^{n+1}$称为$f(x)$在点$x_0$处的$n$阶泰勒余项。

令$x_0=0$，则n阶泰勒公式
$f(x)=f(0)+f'(0)x+\frac{1}{2!}f''(0)x^2+\cdots+\frac{f^{(n)}(0)}{n!}x^n+R_n(x)$……(1)

其中 $R_n(x)=\frac{f^{(n+1)}(\xi)}{(n+1)!}x^{n+1}$，$\xi$在 0 与$x$之间.(1)式称为**麦克劳林公式**

常用五种函数在$x_0=0$处的泰勒公式

(1) $e^x=1+x+\frac{1}{2!}x^2+\cdots+\frac{1}{n!}x^n+\frac{x^{n+1}}{(n+1)!}e^{\xi}$

或$=1+x+\frac{1}{2!}x^2+\cdots+\frac{1}{n!}x^n+o(x^n)$

(2) $\sin x=x-\frac{1}{3!}x^3+\cdots+\frac{x^n}{n!}\sin\frac{n\pi}{2}+\frac{x^{n+1}}{(n+1)!}\sin(\xi+\frac{n+1}{2}\pi)$

或$=x-\frac{1}{3!}x^3+\cdots+\frac{x^n}{n!}\sin\frac{n\pi}{2}+o(x^n)$

(3) $\cos x=1-\frac{1}{2!}x^2+\cdots+\frac{x^n}{n!}\cos\frac{n\pi}{2}+\frac{x^{n+1}}{(n+1)!}\cos(\xi+\frac{n+1}{2}\pi)$

或$=1-\frac{1}{2!}x^2+\cdots+\frac{x^n}{n!}\cos\frac{n\pi}{2}+o(x^n)$

(4) $\ln(1+x)=x-\frac{1}{2}x^2+\frac{1}{3}x^3-\cdots+(-1)^{n-1}\frac{x^n}{n}+\frac{(-1)^n x^{n+1}}{(n+1)(1+\xi)^{n+1}}$

或$=x-\frac{1}{2}x^2+\frac{1}{3}x^3-\cdots+(-1)^{n-1}\frac{x^n}{n}+o(x^n)$

(5) $(1+x)^m=1+mx+\frac{m(m-1)}{2!}x^2+\cdots+\frac{m(m-1)\cdots(m-n+1)}{n!}x^n$
$+\frac{m(m-1)\cdots(m-n+1)}{(n+1)!}x^{n+1}(1+\xi)^{m-n-1}$

或 $(1+x)^m=1+mx+\frac{m(m-1)}{2!}x^2+\cdots+\frac{m(m-1)\cdots(m-n+1)}{n!}x^n+o(x^n)$

12.函数单调性的判断

Th1:

设函数$f(x)$在(a,b)区间内可导，如果对$\forall x\in(a,b)$，都有$f'(x)>0$（或$f'(x)<0$），则函数$f(x)$在(a,b)内是单调增加的（或单调减少）

Th2:

（取极值的必要条件）设函数$f(x)$在x_0处可导，且在x_0处取极值，则$f'(x_0)=0$。

Th3:

（取极值的第一充分条件）设函数$f(x)$在x_0的某一邻域内可微，且$f'(x_0)=0$（或$f(x)$在x_0处连续，但$f'(x_0)$不存在。）

(1)若当x经过x_0时，$f'(x)$由"+"变"-"，则$f(x_0)$为极大值；

(2)若当x经过x_0时，$f'(x)$由"-"变"+"，则$f(x_0)$为极小值；

(3)若$f'(x)$经过$x=x_0$的两侧不变号，则$f(x_0)$不是极值。

Th4:

(取极值的第二充分条件)设$f(x)$在点x_0处有$f''(x)\neq 0$，且$f'(x_0)=0$，则 当$f''(x_0)<0$时，$f(x_0)$为极大值；
当$f''(x_0)>0$时，$f(x_0)$为极小值。
注：如果$f''(x_0)<0$，此方法失效。

13.渐近线的求法

(1)水平渐近线 若$\lim_{x\to+\infty} f(x)=b$，或$\lim_{x\to-\infty} f(x)=b$，则

$y=b$称为函数$y=f(x)$的水平渐近线。

(2)铅直渐近线 若$\lim_{x\to x_0^-} f(x)=\infty$，或$\lim_{x\to x_0^+} f(x)=\infty$，则

$x=x_0$称为$y=f(x)$的铅直渐近线。

(3)斜渐近线 若$a=\lim_{x\to\infty}\frac{f(x)}{x},\quad b=\lim_{x\to\infty}[f(x)-ax]$，则
$y=ax+b$称为$y=f(x)$的斜渐近线。

14.函数凹凸性的判断

Th1: (凹凸性的判别定理）若在 I 上$f''(x)<0$（或$f''(x)>0$），则$f(x)$在 I 上是凸的（或凹的）。

Th2: (拐点的判别定理 1)若在x_0处$f''(x)=0$，（或$f''(x)$不存在），当x变动经过x_0时，$f''(x)$变号，则$(x_0,f(x_0))$为拐点。

Th3: (拐点的判别定理 2)设$f(x)$在x_0点的某邻域内有三阶导数，且$f''(x)=0$，$f'''(x)\neq 0$，则$(x_0,f(x_0))$为拐点。

15.弧微分

$$dS=\sqrt{1+y'^2}dx$$

16.曲率

曲线$y=f(x)$在点(x,y)处的曲率$k=\frac{|y''|}{(1+y'^2)^{\frac{3}{2}}}$。
对于参数方程$\begin{cases}x=\varphi(t)\\y=\psi(t)\end{cases}$,$k=\frac{|\varphi'(t)\psi''(t)-\varphi''(t)\psi'(t)|}{[\varphi'^2(t)+\psi'^2(t)]^{\frac{3}{2}}}$。

17.曲率半径

曲线在点M处的曲率$k(k\neq 0)$与曲线在点M处的曲率半径ρ有如下关系：$\rho=\frac{1}{k}$。

线性代数

行列式

1.行列式按行（列）展开定理

(1) 设$A=(a_{ij})_{n\times n}$，则：$a_{i1}A_{j1}+a_{i2}A_{j2}+\cdots+a_{in}A_{jn}=\begin{cases}|A|,i=j\\0,i\neq j\end{cases}$

或$a_{1i}A_{1j}+a_{2i}A_{2j}+\cdots+a_{ni}A_{nj}=\begin{cases}|A|,i=j\\0,i\neq j\end{cases}$即 $AA^*=A^*A=|A|E$,其中:

$$A^*=\begin{pmatrix}A_{11}&A_{12}&\ldots&A_{1n}\\A_{21}&A_{22}&\ldots&A_{2n}\\\ldots&\ldots&\ldots&\ldots\\A_{n1}&A_{n2}&\ldots&A_{nn}\end{pmatrix}=(A_{ji})=(A_{ij})^T$$

$$D_n=\begin{vmatrix}1&1&\ldots&1\\x_1&x_2&\ldots&x_n\\\ldots&\ldots&\ldots&\ldots\\x_1^{n-1}&x_2^{n-1}&\ldots&x_n^{n-1}\end{vmatrix}=\prod_{1\leq j<i\leq n}(x_i-x_j)$$

(2) 设A,B为n阶方阵，则$|AB|=|A|\,|B|=|B|\,|A|=|BA|$，但$|A\pm B|=|A|\pm|B|$不一定成立。

(3) $|kA|=k^n\,|A|$,A为n阶方阵。

(4) 设A为n阶方阵，$|A^T|=|A|;|A^{-1}|=|A|^{-1}$（若$A$可逆），$|A^*|=|A|^{n-1}$

$n\geq 2$

(5) $\begin{vmatrix}A&O\\O&B\end{vmatrix}=\begin{vmatrix}A&C\\O&B\end{vmatrix}=\begin{vmatrix}A&O\\C&B\end{vmatrix}=|A||B|$

，A,B为方阵，但$\begin{vmatrix}O&A_{m\times m}\\B_{n\times n}&O\end{vmatrix}=(-1)^{mn}|A||B|$。

(6) 范德蒙行列式$D_n=\begin{vmatrix}1&1&\ldots&1\\x_1&x_2&\ldots&x_n\\\ldots&\ldots&\ldots&\ldots\\x_1^{n-1}&x_2^{n1}&\ldots&x_n^{n-1}\end{vmatrix}=\prod_{1\leq j<i\leq n}(x_i-x_j)$

设A是n阶方阵，$\lambda_i(i=1,2\cdots,n)$是A的n个特征值，则
$|A|=\prod_{i=1}^n\lambda_i$

矩阵

矩阵：$m\times n$个数a_{ij}排成m行n列的表格$\begin{bmatrix}a_{11}&a_{12}&\cdots&a_{1n}\\a_{21}&a_{22}&\cdots&a_{2n}\\&\cdots\cdots\cdots\cdots\cdots&&\\a_{m1}&a_{m2}&\cdots&a_{mn}\end{bmatrix}$称为矩阵，简记为$A$，或者

$(a_{ij})_{m\times n}$。若$m=n$，则称A是n阶矩阵或n阶方阵。

矩阵的线性运算

1.矩阵的加法

设$A=(a_{ij}),B=(b_{ij})$是两个$m\times n$矩阵，则$m\times n$ 矩阵$C=c_{ij})=a_{ij}+b_{ij}$称为矩阵A与B的和，记为$A+B=C$。

2.矩阵的数乘

设$A=(a_{ij})$是$m\times n$矩阵，k是一个常数，则$m\times n$矩阵(ka_{ij})称为数k与矩阵A的数乘，记为kA。

3.矩阵的乘法

设$A=(a_{ij})$是$m\times n$矩阵，$B=(b_{ij})$是$n\times s$矩阵，那么$m\times s$矩阵$C=(c_{ij})$，其中
$c_{ij}=a_{i1}b_{1j}+a_{i2}b_{2j}+\cdots+a_{in}b_{nj}=\sum_{k=1}^{n}a_{ik}b_{kj}$称为$AB$的乘积，记为$C=AB$ 。

4. $\mathbf{A^T}$、$\mathbf{A^{-1}}$、$\mathbf{A^*}$三者之间的关系

(1) $\left(A^T\right)^T=A,(AB)^T=B^TA^T,(kA)^T=kA^T,(A\pm B)^T=A^T\pm B^T$

(2) $\left(A^{-1}\right)^{-1}=A,(AB)^{-1}=B^{-1}A^{-1},(kA)^{-1}=\frac{1}{k}A^{-1},$

但$(A\pm B)^{-1}=A^{-1}\pm B^{-1}$不一定成立。

(3) $(A^*)^*=|A|^{n-2}A\ \ (n\geq 3)$，$(AB)^*=B^*A^*,(kA)^*=k^{n-1}A^*\ \ \ (n\geq 2)$

但$(A\pm B)^*=A^*\pm B^*$不一定成立。

(4) $\left(A^{-1}\right)^T=\left(A^T\right)^{-1}$，$\left(A^{-1}\right)^*=(AA^*)^{-1},(A^*)^T=\left(A^T\right)^*$

5.有关$\mathbf{A^*}$的结论

(1) $AA^*=A^*A=|A|E$

(2) $|A^*|=|A|^{n-1}\ (n\geq 2),\quad (kA)^*=k^{n-1}A^*,\quad (A^*)^*=|A|^{n-2}A(n\geq 3)$

(3) 若A可逆，则$A^*=|A|A^{-1},(A^*)^*=\frac{1}{|A|}A$

(4) 若A为n阶方阵，则:

$$r(A^*)=\begin{cases}n, & r(A)=n\\ 1, & r(A)=n-1\\ 0, & r(A)<n-1\end{cases}$$

6.有关$\mathbf{A^{-1}}$的结论

A可逆$\Leftrightarrow AB=E;\Leftrightarrow |A|\neq 0;\Leftrightarrow r(A)=n;$

$\Leftrightarrow A$可以表示为初等矩阵的乘积；$\Leftrightarrow A;\Leftrightarrow Ax=0$。

7.有关矩阵秩的结论

(1) 秩$r(A)$=行秩=列秩;

(2) $r(A_{m\times n})\leq \min(m,n);$

(3) $A\neq 0\Rightarrow r(A)\geq 1;$

(4) $r(A\pm B)\leq r(A)+r(B);$

(5) 初等变换不改变矩阵的秩

(6) $r(A)+r(B)-n\leq r(AB)\leq \min(r(A),r(B))$,特别若$AB=O$
则：$r(A)+r(B)\leq n$

(7) 若A^{-1}存在$\Rightarrow r(AB)=r(B);$若B^{-1}存在
$\Rightarrow r(AB)=r(A);$

若$r(A_{m\times n})=n\Rightarrow r(AB)=r(B);$若$r(A_{m\times s})=n\Rightarrow r(AB)=r\left(A\right)$。

(8) $r(A_{m\times s})=n\Leftrightarrow Ax=0$只有零解

8.分块求逆公式

$$\begin{pmatrix}A & O\\ O & B\end{pmatrix}^{-1}=\begin{pmatrix}A^{-1} & O\\ O & B^{-1}\end{pmatrix};\ \begin{pmatrix}A & C\\ O & B\end{pmatrix}^{-1}=\begin{pmatrix}A^{-1} & -A^{-1}CB^{-1}\\ O & B^{-1}\end{pmatrix};$$

$$\begin{pmatrix}A & O\\ C & B\end{pmatrix}^{-1}=\begin{pmatrix}A^{-1} & O\\ -B^{-1}CA^{-1} & B^{-1}\end{pmatrix};\ \begin{pmatrix}O & A\\ B & O\end{pmatrix}^{-1}=\begin{pmatrix}O & B^{-1}\\ A^{-1} & O\end{pmatrix}$$

这里A，B均为可逆方阵。

向量

1.有关向量组的线性表示

(1)$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性相关$\Leftrightarrow$至少有一个向量可以用其余向量线性表示。

(2)$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性无关，$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$，$\beta$线性相关$\Leftrightarrow\beta$可以由$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$唯一线性表示。

(3) β可以由$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性表示
$\Leftrightarrow r(\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s)=r(\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s,\beta)$ 。

2.有关向量组的线性相关性

(1)部分相关，整体相关；整体无关，部分无关.

(2) ① n个n维向量
$\alpha_1,\alpha_2\cdots\alpha_n$线性无关$\Leftrightarrow|[\alpha_1\alpha_2\cdots\alpha_n]|\neq0$， n个n维向量$\alpha_1,\alpha_2\cdots\alpha_n$线性相关
$\Leftrightarrow|[\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n]|=0$
。

② $n+1$个n维向量线性相关。

③ 若$\alpha_1,\alpha_2\cdots\alpha_S$线性无关，则添加分量后仍线性无关；或一组向量线性相关，去掉某些分量后仍线性相关。

3.有关向量组的线性表示

(1) $\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性相关$\Leftrightarrow$至少有一个向量可以用其余向量线性表示。

(2) $\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性无关，$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$，$\beta$线性相关$\Leftrightarrow\beta$ 可以由$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$唯一线性表示。

(3) β可以由$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性表示
$\Leftrightarrow r(\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s)=r(\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s,\beta)$

4.向量组的秩与矩阵的秩之间的关系

设$r(A_{m\times n})=r$，则A的秩$r(A)$与A的行列向量组的线性相关性关系为：

(1) 若$r(A_{m\times n})=r=m$，则A的行向量组线性无关。

(2) 若$r(A_{m\times n})=r<m$，则A的行向量组线性相关。

(3) 若$r(A_{m\times n})=r=n$，则A的列向量组线性无关。

(4) 若$r(A_{m\times n})=r<n$，则A的列向量组线性相关。

5.n维向量空间的基变换公式及过渡矩阵

若$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$与$\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_n$是向量空间$V$的两组基，则基变换公式为：

$$(\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_n)=(\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n)\begin{bmatrix}c_{11}&c_{12}&\cdots&c_{1n}\\c_{21}&c_{22}&\cdots&c_{2n}\\\cdots&\cdots&\cdots&\cdots\\c_{n1}&c_{n2}&\cdots&c_{nn}\end{bmatrix}=(\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n)C$$

其中C是可逆矩阵，称为由基$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$到基$\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_n$的过渡矩阵。

6.坐标变换公式

若向量γ在基$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$与基$\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_n$的坐标分别是
$X=(x_1,x_2,\cdots,x_n)^T$，

$Y=(y_1,y_2,\cdots,y_n)^T$ 即：$\gamma=x_1\alpha_1+x_2\alpha_2+\cdots+x_n\alpha_n=y_1\beta_1+y_2\beta_2+\cdots+y_n\beta_n$，则向量坐标变换公式为$X=CY$ 或$Y=C^{-1}X$，其中C是从基$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$到基$\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_n$的过渡矩阵。

7.向量的内积

$(\alpha,\beta)=a_1b_1+a_2b_2+\cdots+a_nb_n=\alpha^T\beta=\beta^T\alpha$

8.Schmidt 正交化

若$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$线性无关，则可构造$\beta_1,\beta_2,\cdots,\beta_s$使其两两正交，且$\beta_i$仅是$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_i$的线性组合$(i=1,2,\cdots,n)$，再把$\beta_i$单位化，记$\gamma_i=\frac{\beta_i}{|\beta_i|}$，则$\gamma_1,\gamma_2,\cdots,\gamma_i$是规范正交向量组。其中
$\beta_1=\alpha_1$，$\beta_2=\alpha_2-\frac{(\alpha_2,\beta_1)}{(\beta_1,\beta_1)}\beta_1$，$\beta_3=\alpha_3-\frac{(\alpha_3,\beta_1)}{(\beta_1,\beta_1)}\beta_1-\frac{(\alpha_3,\beta_2)}{(\beta_2,\beta_2)}\beta_2$，

…………

$\beta_s=\alpha_s-\frac{(\alpha_s,\beta_1)}{(\beta_1,\beta_1)}\beta_1-\frac{(\alpha_s,\beta_2)}{(\beta_2,\beta_2)}\beta_2-\cdots-\frac{(\alpha_s,\beta_{s-1})}{(\beta_{s-1},\beta_{s-1})}\beta_{s-1}$

9.正交基及规范正交基

向量空间一组基中的向量如果两两正交，就称为正交基；若正交基中每个向量都是单位向量，就称其为规范正交基。

线性方程组

1．克莱姆法则

线性方程组$\begin{cases}a_{11}x_1+a_{12}x_2+\cdots+a_{1n}x_n=b_1\\a_{21}x_1+a_{22}x_2+\cdots+a_{2n}x_n=b_2\\\cdots\cdots\cdots\cdots\cdots\cdots\cdots\cdots\cdots\\a_{n1}x_1+a_{n2}x_2+\cdots+a_{nn}x_n=b_n\end{cases}$，如果系数行列式$D=|A|\neq0$，则方程组有唯一解，$x_1=\frac{D_1}{D},x_2=\frac{D_2}{D},\cdots,x_n=\frac{D_n}{D}$，其中$D_j$是把$D$中第$j$列元素换成方程组右端的常数列所得的行列式。

2. n阶矩阵A可逆$\Leftrightarrow Ax=0$只有零解。$\Leftrightarrow\forall b,Ax=b$总有唯一解，一般地，
$r(A_{m\times n})=n\Leftrightarrow Ax=0$只有零解。

3.非奇次线性方程组有解的充分必要条件，线性方程组解的性质和解的结构

(1) 设A为$m\times n$矩阵，若$r(A_{m\times n})=m$，则对$Ax=b$而言必有$r(A)=r(A\vdots b)=m$，从而$Ax=b$有解。

(2) 设$x_1,x_2,\cdots x_s$为$Ax=b$的解，则$k_1x_1+k_2x_2\cdots+k_sx_s$当$k_1+k_2+\cdots+k_s=1$时仍为$Ax=b$的解；但当$k_1+k_2+\cdots+k_s=0$时，则为$Ax=0$的解。特别$\frac{x_1+x_2}{2}$为$Ax=b$的解；$2x_3-(x_1+x_2)$为$Ax=0$的解。

(3) 非齐次线性方程组$Ax=b$无解$\Leftrightarrow r(A)+1=r(\overline{A}) \Leftrightarrow b$不能由$A$的列向量$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_n$线性表示。

4.奇次线性方程组的基础解系和通解，解空间，非奇次线性方程组的通解

(1) 齐次方程组$Ax=0$恒有解(必有零解)。当有非零解时，由于解向量的任意线性组合仍是该齐次方程组的解向量，因此$Ax=0$的全体解向量构成一个向量空间，称为该方程组的解空间，解空间的维数是$n-r(A)$，解空间的一组基称为齐次方程组的基础解系。

(2) $\eta_1,\eta_2,\cdots,\eta_t$是$Ax=0$的基础解系，即：

1. $\eta_1,\eta_2,\cdots,\eta_t$是$Ax=0$的解；
2. $\eta_1,\eta_2,\cdots,\eta_t$线性无关；
3. $Ax=0$的任一解都可以由$\eta_1,\eta_2,\cdots,\eta_t$线性表出.
   $k_1\eta_1+k_2\eta_2+\cdots+k_t\eta_t$是$Ax=0$的通解，其中$k_1,k_2,\cdots,k_t$是任意常数。

矩阵的特征值和特征向量

1.矩阵的特征值和特征向量的概念及性质

(1) 设λ是A的一个特征值，则 $kA,aA+bE,A^2,A^m,f(A),A^T,A^{-1},A^*$有一个特征值分别为$k\lambda,a\lambda+b,\lambda^2,\lambda^m,f(\lambda),\lambda,\lambda^{-1},\frac{|A|}{\lambda}$,且对应特征向量相同（$A^T$ 例外）。

(2)若$\lambda_1,\lambda_2,\cdots,\lambda_n$为$A$的$n$个特征值，则$\sum_{i=1}^n\lambda_i=\sum_{i=1}^n a_{ii},\prod_{i=1}^n\lambda_i=|A|$,从而$|A|\neq 0\Leftrightarrow A$没有特征值。

(3)设$\lambda_1,\lambda_2,\cdots,\lambda_s$为$A$的$s$个特征值，对应特征向量为$\alpha_1,\alpha_2,\cdots,\alpha_s$，

若: $\alpha=k_1\alpha_1+k_2\alpha_2+\cdots+k_s\alpha_s$,

则: $A^n\alpha=k_1A^n\alpha_1+k_2A^n\alpha_2+\cdots+k_sA^n\alpha_s=k_1\lambda_1^n\alpha_1+k_2\lambda_2^n\alpha_2+\cdots k_s\lambda_s^n\alpha_s$ 。

2.相似变换、相似矩阵的概念及性质

(1) 若$A\sim B$，则

1. $A^T\sim B^T,A^{-1}\sim B^{-1},,A^*\sim B^*$
2. $|A|=|B|,\sum_{i=1}^n A_{ii}=\sum_{i=1}^n b_{ii},r(A)=r(B)$
3. $|\lambda E-A|=|\lambda E-B|$，对$\forall\lambda$成立

3.矩阵可相似对角化的充分必要条件

(1)设A为n阶方阵，则A可对角化$\Leftrightarrow$对每个k_i重根特征值λ_i，有$n-r(\lambda_iE-A)=k_i$

(2) 设A可对角化，则由$P^{-1}AP=\Lambda$,有$A=P\varLambda P^{-1}$，从而$A^n=P\Lambda^nP^{-1}$

(3) 重要结论

1. 若$A\sim B,C\sim D$，则$\begin{bmatrix}A&O\\O&C\end{bmatrix}\sim\begin{bmatrix}B&O\\O&D\end{bmatrix}$.
2. 若$A\sim B$，则$f(A)\sim f(B),|f(A)|\sim|f(B)|$，其中$f(A)$为关于$n$阶方阵$A$的多项式。
3. 若A为可对角化矩阵，则其非零特征值的个数(重根重复计算)＝秩(A)

4.实对称矩阵的特征值、特征向量及相似对角阵

(1)相似矩阵：设A,B为两个n阶方阵，如果存在一个可逆矩阵P，使得$B=P^{-1}AP$成立，则称矩阵A与B相似，记为$A\sim B$。

(2)相似矩阵的性质：如果$A\sim B$则有：

1. $A^T\sim B^T$

2. $A^{-1}\sim B^{-1}$ （若A，B均可逆）
3. $A^k\sim B^k$ （k为正整数）
4. $|\lambda E-A|=|\lambda E-B|$，从而$A,B$
   有相同的特征值
5. $|A|=|B|$，从而A,B同时可逆或者不可逆
6. 秩$(A)=$秩$(B),|\lambda E-A|=|\lambda E-B|$，$A,B$不一定相似

二次型

1.$\mathbf{n}$个变量$\mathbf{x_1,x_2,\cdots,x_n}$的二次齐次函数

$f(x_1,x_2,\cdots,x_n)=\sum_{i=1}^n\sum_{j=1}^n a_{ij}x_iy_j$，其中$a_{ij}=a_{ji}(i,j=1,2,\cdots,n)$，称为$n$元二次型，简称二次型. 若令$x=\begin{bmatrix}x_1\\x_1\\\vdots\\x_n\end{bmatrix},A=\begin{bmatrix}a_{11}&a_{12}&\cdots&a_{1n}\\a_{21}&a_{22}&\cdots&a_{2n}\\\cdots&\cdots&\cdots&\cdots\\a_{n1}&a_{n2}&\cdots&a_{nn}\end{bmatrix}$,这二次型$f$可改写成矩阵向量形式

$f=x^TAx$。其中A称为二次型矩阵，因为$a_{ij}=a_{ji}(i,j=1,2,\cdots,n)$，所以二次型矩阵均为对称矩阵，且二次型与对称矩阵一一对应，并把矩阵A的秩称为二次型的秩。

2.惯性定理，二次型的标准形和规范形

(1) 惯性定理

对于任一二次型，不论选取怎样的合同变换使它化为仅含平方项的标准型，其正负惯性指数与所选变换无关，这就是所谓的惯性定理。

(2) 标准形

二次型$f=(x_1,x_2,\cdots,x_n)=x^TAx$经过合同变换$x=Cy$化为$f=x^TAx=y^TC^TAC$

$y=\sum_{i=1}^r d_iy_i^2$称为 $f(r\le n)$的标准形。在一般的数域内，二次型的标准形不是唯一的，与所作的合同变换有关，但系数不为零的平方项的个数由$r(A)$唯一确定。

(3) 规范形

任一实二次型f都可经过合同变换化为规范形$f=z_1^2+z_2^2+\cdots z_p^2-z_{p+1}^2-\cdots-z_r^2$，其中$r$为$A$的秩，$p$为正惯性指数，$r-p$为负惯性指数，且规范型唯一。

3.用正交变换和配方法化二次型为标准形，二次型及其矩阵的正定性

设A正定$\Rightarrow kA(k>0),A^T,A^{-1},A^*$正定；$|A|>0$,$A$可逆；$a_{ii}>0$，且$|A_{ii}|>0$

A，B正定$\Rightarrow A+B$正定，但AB，BA不一定正定

A正定$\Leftrightarrow f(x)=x^TAx>0,\forall x\neq 0$

$\Leftrightarrow$ A的各阶顺序主子式全大于零

$\Leftrightarrow$ A的所有特征值大于零

$\Leftrightarrow$ A的正惯性指数为n

$\Leftrightarrow$存在可逆阵P使$A=P^TP$

$\Leftrightarrow$存在正交矩阵Q，使$Q^TAQ=Q^{-1}AQ=\begin{pmatrix}\lambda_1&&\\&\ddots&\\&&\lambda_n\end{pmatrix}$,

其中$\lambda_i > 0, i = 1, 2, \cdots, n$.正定$\Rightarrow$ $kA(k>0), A^T, A^{-1}, A^*$正定； $|A|>0, A$可逆；$a_{ii}>0$，且$|A_{ii}|>0$ 。

概率论和数理统计

随机事件和概率

1.事件的关系与运算

(1) 子事件：$A \subset B$，若A发生，则B发生。

(2) 相等事件：$A = B$，即$A \subset B$，且$B \subset A$ 。

(3) 和事件：$A \bigcup B$（或$A + B$），A与B中至少有一个发生。

(4) 差事件：$A - B$，A发生但B不发生。

(5) 积事件：$A \bigcap B$（或AB），A与B同时发生。

(6) 互斥事件（互不相容）：$A \bigcap B$=$\varnothing$。

(7) 互逆事件（对立事件）：
$A \bigcap B = \varnothing, A \bigcup B = \Omega, A = \bar{B}, B = \bar{A}$

2.运算律

(1) 交换律：$A \bigcup B = B \bigcup A, A \bigcap B = B \bigcap A$
(2) 结合律：$(A \bigcup B) \bigcup C = A \bigcup (B \bigcup C)$
(3) 分配律：$(A \bigcap B) \bigcap C = A \bigcap (B \bigcap C)$

3.德▪摩根律

$\overline{A \bigcup B} = \bar{A} \bigcap \bar{B}$ $\overline{A \bigcap B} = \bar{A} \bigcup \bar{B}$

4.完全事件组

$A_1 A_2 \cdots A_n$两两互斥，且和事件为必然事件，即$A_i \bigcap A_j = \varnothing, i \neq j, \bigcup^n{}_{i=1} = \Omega$

5.概率的基本公式

(1)条件概率:
$P(B|A) = \frac{P(AB)}{P(A)}$,表示$A$发生的条件下，$B$发生的概率。

(2)全概率公式：

$$P(A) = \sum_{i=1}^{n} P(A|B_i)P(B_i), B_i B_j = \varnothing, i \neq j, \bigcup^n{}_{i=1}\ B_i = \Omega$$

(3) Bayes 公式：

$$P(B_j|A) = \frac{P(A|B_j)P(B_j)}{\sum\limits_{i=1}^{n} P(A|B_i)P(B_i)}, j = 1, 2, \cdots, n$$

注：上述公式中事件B_i的个数可为可列个。

(4)乘法公式：
$P(A_1 A_2) = P(A_1)P(A_2|A_1) = P(A_2)P(A_1|A_2)$
$P(A_1 A_2 \cdots A_n) = P(A_1)P(A_2|A_1)P(A_3|A_1 A_2) \cdots P(A_n|A_1 A_2 \cdots A_{n-1})$

6.事件的独立性

(1)A与B相互独立

$\Leftrightarrow P(AB)=P(A)P(B)$

(2)A，B，C两两独立
$\Leftrightarrow P(AB)=P(A)P(B)$;$P(BC)=P(B)P(C)$;$P(AC)=P(A)P(C)$;

(3)A，B，C相互独立
$\Leftrightarrow P(AB)=P(A)P(B)$; $P(BC)=P(B)P(C)$;
$P(AC)=P(A)P(C)$; $P(ABC)=P(A)P(B)P(C)$

7.独立重复试验

将某试验独立重复n次，若每次实验中事件 A 发生的概率为p，则n次试验中A发生k次的概率为：
$P(X=k)=C_n^k p^k(1-p)^{n-k}$

8.重要公式与结论
$(1)P(\bar{A})=1-P(A)$

$(2)P(A\bigcup B)=P(A)+P(B)-P(AB)$
$P(A\bigcup B\bigcup C)=P(A)+P(B)+P(C)-P(AB)-P(BC)-P(AC)+P(ABC)$

$(3)P(A-B)=P(A)-P(AB)$

$(4)P(A\bar{B})=P(A)-P(AB),P(A)=P(AB)+P(A\bar{B})$,
$P(A\bigcup B)=P(A)+P(\bar{A}B)=P(AB)+P(A\bar{B})+P(\bar{A}B)$

(5)条件概率$P(\centerdot|B)$满足概率的所有性质，
例如：. $P(\bar{A}_1|B)=1-P(A_1|B)$
$P(A_1\bigcup A_2|B)=P(A_1|B)+P(A_2|B)-P(A_1A_2|B)$
$P(A_1A_2|B)=P(A_1|B)P(A_2|A_1B)$

(6)若$A_1,A_2,\cdots,A_n$相互独立，则$P(\bigcap\limits_{i=1}^{n}A_i)=\prod\limits_{i=1}^{n}P(A_i)$,
$P(\bigcup\limits_{i=1}^{n}A_i)=\prod\limits_{i=1}^{n}(1-P(A_i))$

(7)互斥、互逆与独立性之间的关系：
A与B互逆$\Rightarrow$ A与B互斥，但反之不成立，A与B互斥（或互逆）且均非零概率事件$\Rightarrow$$A$与$B$不独立.

(8)若$A_1,A_2,\cdots,A_m,B_1,B_2,\cdots,B_n$相互独立，则$f(A_1,A_2,\cdots,A_m)$与$g(B_1,B_2,\cdots,B_n)$也相互独立，其中$f(\centerdot),g(\centerdot)$分别表示对相应事件做任意事件运算后所得的事件，另外，概率为 1（或 0）的事件与任何事件相互独立.

随机变量及其概率分布

1.随机变量及概率分布

取值带有随机性的变量，严格地说是定义在样本空间上，取值于实数的函数称为随机变量，概率分布通常指分布函数或分布律

2.分布函数的概念与性质

定义： $F(x)=P(X\le x),-\infty<x<+\infty$

性质：(1)$0\le F(x)\le 1$

(2) $F(x)$单调不减

(3) 右连续$F(x+0)=F(x)$

(4) $F(-\infty)=0,F(+\infty)=1$

3.离散型随机变量的概率分布

$P(X=x_i)=p_i, i=1,2,\cdots,n,\cdots \qquad p_i\geq 0, \sum_{i=1}^{\infty}p_i=1$

4.连续型随机变量的概率密度

概率密度$f(x)$;非负可积，且:

(1)$f(x)\geq 0,$

(2)$\int_{-\infty}^{+\infty}f(x)dx=1$

(3)x为$f(x)$的连续点，则:

$f(x)=F'(x)$分布函数$F(x)=\int_{-\infty}^{x}f(t)dt$

5.常见分布

(1) 0-1 分布:$P(X=k)=p^k(1-p)^{1-k}, k=0,1$

(2) 二项分布:$B(n,p)$: $P(X=k)=C_n^k p^k(1-p)^{n-k}, k=0,1,\cdots,n$

(3) **Poisson**分布:$p(\lambda)$: $P(X=k)=\frac{\lambda^k}{k!}e^{-\lambda}, \lambda>0, k=0,1,2\cdots$

(4) 均匀分布$U(a,b)$: $f(x)=\{ \begin{array}{c} \frac{1}{b-a}, a<x<b \\ 0, \end{array}$

(5) 正态分布:$N(\mu,\sigma^2):\varphi(x)=\frac{1}{\sqrt{2\pi}\sigma}e^{-\frac{(x-\mu)^2}{2\sigma^2}}, \sigma>0, \infty<x<+\infty$

(6)指数分布:$E(\lambda):f(x)=\{ \begin{array}{c} \lambda e^{-\lambda x}, x>0, \lambda>0 \\ 0, \end{array}$

(7)几何分布:$G(p):P(X=k)=(1-p)^{k-1}p, 0<p<1, k=1,2,\cdots.$

(8)超几何分布: $H(N,M,n):P(X=k)=\frac{C_M^k C_{N-M}^{n-k}}{C_N^n}, k=0,1,\cdots,min(n,M)$

6.随机变量函数的概率分布

(1)离散型：$P(X=x_1)=p_i, Y=g(X)$

则: $P(Y=y_j)=\sum_{g(x_i)=y_i}P(X=x_i)$

(2)连续型：X~$f_X(x), Y=g(x)$

则:$F_y(y)=P(Y\leq y)=P(g(X)\leq y)=\int_{g(x)\leq y}f_x(x)dx$，$f_Y(y)=F'_Y(y)$

7.重要公式与结论

(1) $X\sim N(0,1)\Rightarrow\varphi(0)=\frac{1}{\sqrt{2\pi}}, \Phi(0)=\frac{1}{2}, \Phi(-a)=P(X\leq -a)=1-\Phi(a)$

(2) $X\sim N\left(\mu,\sigma^2\right)\Rightarrow\frac{X-\mu}{\sigma}\sim N\left(0,1\right), P(X\leq a)=\Phi(\frac{a-\mu}{\sigma})$

(3) $X\sim E(\lambda)\Rightarrow P(X>s+t|X>s)=P(X>t)$

(4) $X\sim G(p)\Rightarrow P(X=m+k|X>m)=P(X=k)$

(5) 离散型随机变量的分布函数为阶梯间断函数；连续型随机变量的分布函数为连续函数，但不一定为处处可导函数。

(6) 存在既非离散也非连续型随机变量。

多维随机变量及其分布

1.二维随机变量及其联合分布

由两个随机变量构成的随机向量(X,Y)，联合分布为$F(x,y)=P(X\le x,Y\le y)$

2.二维离散型随机变量的分布

(1) 联合概率分布律 $P\{X=x_i,Y=y_j\}=p_{ij};i,j=1,2,\cdots$

(2) 边缘分布律 $p_{i\cdot}=\sum_{j=1}^{\infty}p_{ij},i=1,2,\cdots p_{\cdot j}=\sum_{i}^{\infty}p_{ij},j=1,2,\cdots$

(3) 条件分布律 $P\{X=x_i|Y=y_j\}=\frac{p_{ij}}{p_{\cdot j}}$
$P\{Y=y_j|X=x_i\}=\frac{p_{ij}}{p_{i\cdot}}$

3. 二维连续性随机变量的密度

(1) 联合概率密度$f(x,y)$：

1. $f(x,y)\ge 0$
2. $\int_{-\infty}^{+\infty}\int_{-\infty}^{+\infty}f(x,y)dxdy=1$

(2) 分布函数：$F(x,y)=\int_{-\infty}^{x}\int_{-\infty}^{y}f(u,v)dudv$

(3) 边缘概率密度：$f_X\left(x\right)=\int_{-\infty}^{+\infty}f\left(x,y\right)dy\ f_Y(y)=\int_{-\infty}^{+\infty}f(x,y)dx$

(4) 条件概率密度：$f_{X|Y}\left(x|y\right)=\frac{f(x,y)}{f_Y(y)}\ f_{Y|X}(y|x)=\frac{f(x,y)}{f_X(x)}$

4.常见二维随机变量的联合分布

(1) 二维均匀分布：$(x,y)\sim U(D)$,$f(x,y)=\begin{cases}\frac{1}{S(D)},(x,y)\in D\\0,\text{其他}\end{cases}$

(2) 二维正态分布：$(X,Y)\sim N(\mu_1,\mu_2,\sigma_1^2,\sigma_2^2,\rho)$,$(X,Y)\sim N(\mu_1,\mu_2,\sigma_1^2,\sigma_2^2,\rho)$

$f(x,y)=\frac{1}{2\pi\sigma_1\sigma_2\sqrt{1-\rho^2}}.\exp\left\{\frac{-1}{2(1-\rho^2)}[\frac{(x-\mu_1)^2}{\sigma_1^2}-2\rho\frac{(x-\mu_1)(y-\mu_2)}{\sigma_1\sigma_2}+\frac{(y-\mu_2)^2}{\sigma_2^2}]\right\}$

5.随机变量的独立性和相关性

X和Y的相互独立:$\Leftrightarrow F\left(x,y\right)=F_X\left(x\right)F_Y\left(y\right)$:

$\Leftrightarrow p_{ij}=p_{i\cdot}\cdot p_{\cdot j}$（离散型）
$\Leftrightarrow f\left(x,y\right)=f_X\left(x\right)f_Y\left(y\right)$（连续型）

X和Y的相关性:

相关系数$\rho_{XY}=0$时，称X和Y不相关，
否则称X和Y相关

6.两个随机变量简单函数的概率分布

离散型：$P\left(X=x_i,Y=y_i\right)=p_{ij},Z=g\left(X,Y\right)$ 则:

$P(Z=z_k)=P\left\{g\left(X,Y\right)=z_k\right\}=\sum_{g(x_i,y_i)=z_k}P\left(X=x_i,Y=y_j\right)$

连续型：$\left(X,Y\right)\sim f\left(x,y\right),Z=g\left(X,Y\right)$
则:

$F_z\left(z\right)=P\left\{g\left(X,Y\right)\le z\right\}=\iint_{g(x,y)\le z}f(x,y)dxdy$，$f_z(z)=F'_z(z)$

7.重要公式与结论

(1) 边缘密度公式： $f_X(x)=\int_{-\infty}^{+\infty} f(x,y)dy$,
$f_Y(y)=\int_{-\infty}^{+\infty} f(x,y)dx$

(2) $P\{(X,Y)\in D\}=\iint_D f(x,y)dxdy$

(3) 若(X,Y)服从二维正态分布$N(\mu_1,\mu_2,\sigma_1^2,\sigma_2^2,\rho)$
则有：

1. $X\sim N\left(\mu_1,\sigma_1^2\right),Y\sim N(\mu_2,\sigma_2^2)$.
2. X与Y相互独立$\Leftrightarrow \rho=0$，即X与Y不相关。
3. $C_1X+C_2Y\sim N(C_1\mu_1+C_2\mu_2,C_1^2\sigma_1^2+C_2^2\sigma_2^2+2C_1C_2\sigma_1\sigma_2\rho)$
4. X关于$Y=y$的条件分布为： $N(\mu_1+\rho\frac{\sigma_1}{\sigma_2}(y-\mu_2),\sigma_1^2(1-\rho^2))$
5. Y关于$X=x$的条件分布为： $N(\mu_2+\rho\frac{\sigma_2}{\sigma_1}(x-\mu_1),\sigma_2^2(1-\rho^2))$

(4) 若X与Y独立，且分别服从$N(\mu_1,\sigma_1^2),N(\mu_1,\sigma_2^2)$,
则：$(X,Y)\sim N(\mu_1,\mu_2,\sigma_1^2,\sigma_2^2,0)$,

C_1X+C_2Y~$N(C_1\mu_1+C_2\mu_2,C_1^2\sigma_1^2C_2^2\sigma_2^2)$.

(5) 若X与Y相互独立，$f(x)$和$g(x)$为连续函数， 则$f(X)$和$g(Y)$也相互独立。

随机变量的数字特征

1.数学期望

离散型：$P\{X=x_i\}=p_i,E(X)=\sum_i x_ip_i$；

连续型： $X\sim f(x),E(X)=\int_{-\infty}^{+\infty} xf(x)dx$

性质：

(1) $E(C)=C,E[E(X)]=E(X)$

(2) $E(C_1X+C_2Y)=C_1E(X)+C_2E(Y)$

(3) 若X和Y独立，则$E(XY)=E(X)E(Y)$

(4)$[E(XY)]^2\le E(X^2)E(Y^2)$

2.方差：$D(X)=E[X-E(X)]^2=E(X^2)-[E(X)]^2$

3.标准差：$\sqrt{D(X)}$,

4.离散型：$D(X)=\sum_i [x_i-E(X)]^2p_i$

5.连续型：$D(X)=\int_{-\infty}^{+\infty} [x-E(X)]^2f(x)dx$

性质：

(1) $D(C)=0,D[E(X)]=0,D[D(X)]=0$

(2) X与Y相互独立，则$D(X\pm Y)=D(X)+D(Y)$

(3) $D(C_1X+C_2)=C_1^2D(X)$

(4) 一般有
$D(X\pm Y)=D(X)+D(Y)\pm 2Cov(X,Y)=D(X)+D(Y)\pm 2\rho\sqrt{D(X)}\sqrt{D(Y)}$

(5) $D(X)<E(X-C)^2,C\ne E(X)$

(6) $D(X)=0\Leftrightarrow P\{X=C\}=1$

6.随机变量函数的数学期望

(1) 对于函数$Y=g(x)$

X为离散型：$P\{X=x_i\}=p_i, E(Y)=\sum_i g(x_i)p_i$；

X为连续型：$X\sim f(x), E(Y)=\int_{-\infty}^{+\infty} g(x)f(x)dx$

(2) $Z=g(X,Y)$;$(X,Y)\sim P\{X=x_i,Y=y_j\}=p_{ij}$; $E(Z)=\sum_i\sum_j g(x_i,y_j)p_{ij}$
$(X,Y)\sim f(x,y)$;$E(Z)=\int_{-\infty}^{+\infty}\int_{-\infty}^{+\infty} g(x,y)f(x,y)dxdy$

7.协方差

$Cov(X,Y)=E\left[(X-E(X)(Y-E(Y))\right]$

8.相关系数

$\rho_{XY}=\frac{Cov(X,Y)}{\sqrt{D(X)}\sqrt{D(Y)}}$,$k$阶原点矩 $E(X^k)$;
k阶中心矩 $E\left\{[X-E(X)]^k\right\}$

性质：

(1) $Cov(X,Y)=Cov(Y,X)$

(2) $Cov(aX,bY)=abCov(Y,X)$

(3) $Cov(X_1+X_2,Y)=Cov(X_1,Y)+Cov(X_2,Y)$

(4) $\left|\rho\left(X,Y\right)\right|\le 1$

(5) $\rho\left(X,Y\right)=1\Leftrightarrow P\left(Y=aX+b\right)=1$，其中$a>0$

$\rho\left(X,Y\right)=-1\Leftrightarrow P\left(Y=aX+b\right)=1$
，其中$a<0$

9.重要公式与结论

(1) $D(X)=E(X^2)-E^2(X)$

(2) $Cov(X,Y)=E(XY)-E(X)E(Y)$

(3) $\left|\rho\left(X,Y\right)\right|\le 1$,且 $\rho\left(X,Y\right)=1\Leftrightarrow P\left(Y=aX+b\right)=1$，其中$a>0$

$\rho\left(X,Y\right)=-1\Leftrightarrow P\left(Y=aX+b\right)=1$，其中$a<0$

(4) 下面 5 个条件互为充要条件：

$\rho(X,Y)=0\Leftrightarrow Cov(X,Y)=0\Leftrightarrow E(X,Y)=E(X)E(Y)\Leftrightarrow D(X+Y)=D(X)+D(Y)$
$\Leftrightarrow D(X-Y)=D(X)+D(Y)$

注：X与Y独立为上述 5 个条件中任何一个成立的充分条件，但非必要条件。

数理统计的基本概念

1.基本概念

总体：研究对象的全体，它是一个随机变量，用X表示。

个体：组成总体的每个基本元素。

简单随机样本：来自总体X的n个相互独立且与总体同分布的随机变量$X_1,X_2\cdots,X_n$，称为容量为n的简单随机样本，简称样本。

统计量：设$X_1,X_2\cdots,X_n$,是来自总体X的一个样本，$g(X_1,X_2\cdots,X_n)$）是样本的连续函数，且$g()$中不含任何未知参数，则称$g(X_1,X_2\cdots,X_n)$为统计量。

样本均值：$\overline{X} = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} X_i$

样本方差：$S^2 = \frac{1}{n-1}\sum_{i=1}^{n}\left(X_i - \overline{X}\right)^2$

样本矩：样本k阶原点矩：$A_k = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} X_i^k, k = 1, 2, \cdots$

样本k阶中心矩：$B_k = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n}\left(X_i - \overline{X}\right)^k, k = 1, 2, \cdots$

2.分布

χ^2分布：$\chi^2 = X_1^2 + X_2^2 + \cdots + X_n^2 \sim \chi^2(n)$，其中$X_1, X_2 \cdots, X_n$,相互独立，且同服从$N(0,1)$

t分布：$T = \frac{X}{\sqrt{Y/n}} \sim t(n)$，其中$X \sim N(0,1), Y \sim \chi^2(n)$,且$X$，$Y$ 相互独立。

F分布：$F = \frac{X/n_1}{Y/n_2} \sim F(n_1, n_2)$，其中$X \sim \chi^2(n_1), Y \sim \chi^2(n_2)$,且$X$，$Y$相互独立。

分位数：若$P(X \leq x_\alpha) = \alpha$,则称$x_\alpha$为$X$的$\alpha$分位数

3.正态总体的常用样本分布

(1) 设$X_1, X_2 \cdots, X_n$为来自正态总体$N(\mu, \sigma^2)$的样本，

$\overline{X} = \frac{1}{n}\sum_{i=1}^{n} X_i, S^2 = \frac{1}{n-1}\sum_{i=1}^{n}\left(X_i - \overline{X}\right)^2$,则：

1. $\overline{X} \sim N\left(\mu, \frac{\sigma^2}{n}\right)$ 或者$\frac{\overline{X}-\mu}{\frac{\sigma}{\sqrt{n}}} \sim N(0,1)$
2. $\frac{(n-1)S^2}{\sigma^2} = \frac{1}{\sigma^2}\sum_{i=1}^{n}\left(X_i - \overline{X}\right)^2 \sim \chi^2(n-1)$
3. $\frac{1}{\sigma^2}\sum_{i=1}^{n}\left(X_i - \mu\right)^2 \sim \chi^2(n)$

4) $\frac{\overline{X}-\mu}{S/\sqrt{n}} \sim t(n-1)$

4.重要公式与结论

(1) 对于$\chi^2 \sim \chi^2(n)$，有$E(\chi^2(n)) = n, D(\chi^2(n)) = 2n$;

(2) 对于$T \sim t(n)$，有$E(T) = 0, D(T) = \frac{n}{n-2}(n > 2)$;

(3) 对于F~$F(m,n)$，有 $\frac{1}{F} \sim F(n,m), F_{a/2}(m,n) = \frac{1}{F_{1-a/2}(n,m)}$;

(4) 对于任意总体X，有 $E(\overline{X}) = E(X), E(S^2) = D(X), D(\overline{X}) = \frac{D(X)}{n}$